

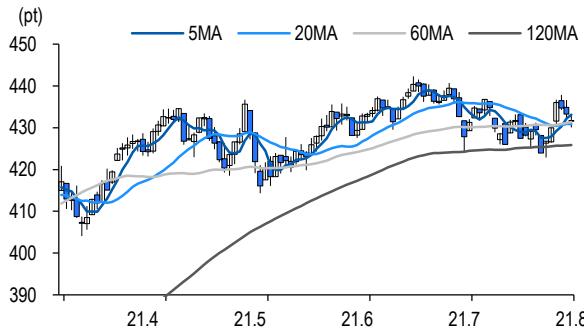


선물옵션시장 지표

2021.8.10

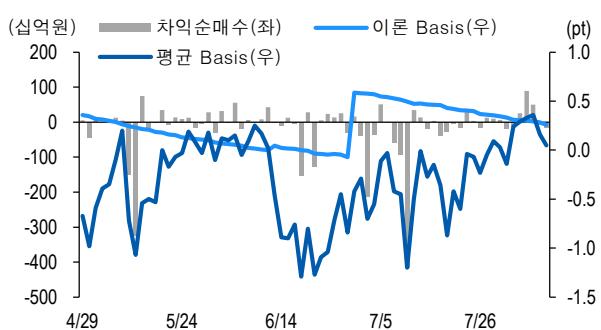
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	431.65	-0.38	-1.64	7,972.9	-
선물 9월물	432.00	-0.36	-1.55	22,694.5	253,363
선물 12월물	431.45	-0.39	-1.70	78.0	29,824
8월물(mini)	431.96	-0.36	-1.54	1,844.1	78,541
9월물(mini)	432.00	-0.36	-1.70	21.8	21,455



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.26	0.05	0.35	-0.05%
베이시스(mini)	0.02	0.05	0.31	0.01%
제1스프레드(SP)	0.16	-0.50	-0.50	-0.15%
합성선물 베이시스(ATM)	0.02	0.28	0.28	0.06%



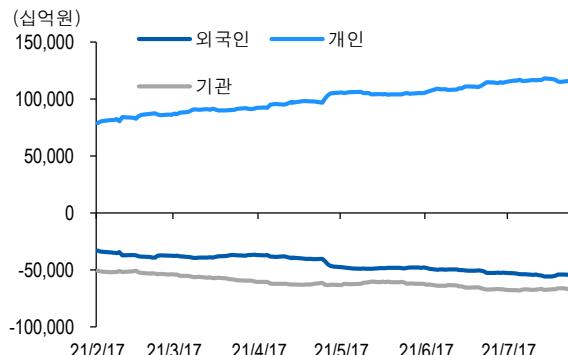
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-206.2	-20.4	-226.6	-0.6	-143.6	-359.7	-1.2	5.1	0.9	27.6
개인	950.1	134.3	1,084.4	0.0	-1.9	126.3	13.5	-3.5	-0.3	70.5
기관	-747.3	-115.9	-863.2	-14.4	-173.9	297.7	-17.0	0.6	-0.8	-98.7
금융투자	-418.2	-19.0	-437.3	-12.2	-25.2	143.5	-12.6	0.6	-0.9	-123.4
투신	-35.9	-11.7	-47.6	0.0	-36.8	98.1	0.0	0.0	0.0	38.0
은행+보험+기타금융	-11.5	-99.9	-111.4	0.0	-8.9	28.1	-4.3	0.0	0.1	-2.8
연기금+국가지자체	-172.5	-2.3	-174.8	-2.2	-91.4	27.9	0.0	0.0	0.0	-10.5
기타법인	3.4	2.0	5.4	0.0	-0.3	-64.3	4.8	-2.3	0.2	0.6

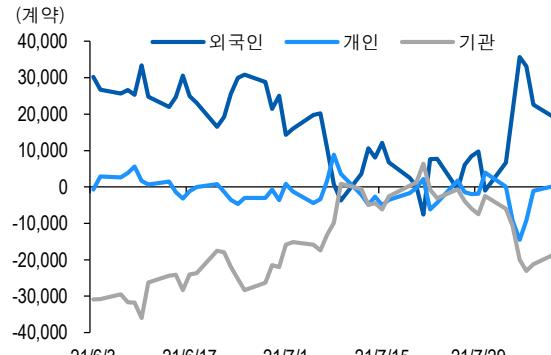
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

(계약, 십억원)							
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금
Call	1,636,130	284.1	970,618	12.8%	지수옵션 전체	3,045,953	563.2
Put	1,409,823	279.1	1,683,882	13.3%	PCR(금액기준)	0.98	VKOSPI 14.28%(+0.10%p)
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	440.0(K+3)	0.20	-0.38	328,594	42,395	3,400	12.8
	437.5(K+2)	0.43	-0.69	330,309	31,884	6,427	12.3
	435.0(K+1)	0.98	-1.02	255,624	29,218	5,676	12.5
	432.5(K+0)	1.97	-1.28	135,830	18,846	2,294	13.1
	430.0(K-1)	3.42	-1.49	47,687	18,989	-1,201	13.8
Put	435.0(K+1)	4.04	0.59	18,389	13,104	-954	10.8
	432.5(K+0)	2.54	0.34	69,950	14,910	1,873	11.7
	430.0(K-1)	1.50	0.13	163,867	22,953	-2,957	12.5
	427.5(K-2)	0.84	0.00	239,652	26,191	1,055	13.2
	425.0(K-3)	0.45	-0.04	233,826	38,019	-2,617	13.9

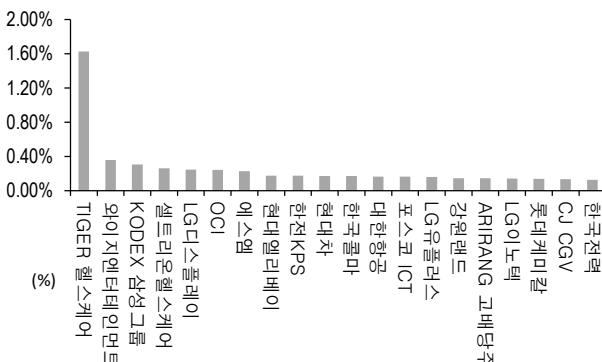
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

역시적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목)

(계약, 십억원)										
	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)
주식선물 전체	4,123,541	3,911.7	7,072,790	95,479	-15,806	95,740	-67,574	27.6	70.5	-98.7
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
NAVER	448,000	0.67	242.0	103.2	68,862	-12,177	0.03%	1,254	-1,479	228
하나금융지주	44,400	2.42	63.0	99.0	73,473	-18,791	0.02%	6,566	-6,784	1,183
삼성 SDI	779,000	0.39	147.3	98.7	33,505	-2,811	0.04%	596	734	-1,331
SK 텔레콤	303,000	-0.82	35.7	92.5	16,420	-2,370	0.07%	786	69	-855
LG 화학	845,000	0.36	106.4	91.2	16,014	294	-0.04%	920	176	-1,095
삼성전자	81,700	0.00	1,102.3	87.7	1,024,860	-94,987	0.08%	-2,465	60,234	-58,645
엔씨소프트	820,000	-0.36	36.1	77.0	6,416	-538	0.02%	128	298	-427
LG 전자	161,000	2.88	119.4	64.8	51,679	-2,700	0.07%	6,849	-2,719	-4,130
LG 디스플레이	21,900	-1.57	28.4	63.3	422,061	-62,035	0.25%	-6,516	8,007	-1,473
기아	86,300	0.82	68.5	61.0	75,181	-2,375	0.06%	5,677	-1,015	-4,657

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터